

# Central Daily Market Report

2020年11月13日(金)

セントラル短資株式会社 総合企画部

## ●資金需給

単位：億円	2020年11月13日 需給速報	2020年11月16日 需給予想	2020年11月17日 当社予想
銀行券	200	800	0
財政	▲ 22,500	▲ 32,900	▲ 4,000
資金過不足	▲ 22,300	▲ 32,100	▲ 4,000
<b>金融調節</b>			
	スタート	エンド	スタート
貸出			
全店共通			
国債買現			
国債売現			
国庫短期証買入			
国債買入			
CP等買入		▲ 700	▲ 1,600
貸出支援基金(成)			
貸出支援基金(貸)			
被災地支援			
社債等買入			
新型コロナ対応金融支援特別			
ETF買入	100		
国債補完供給	▲ 300	1,100	300
<small>※ドル資金供給用担保提供供給</small>			
当預増減	▲ 22,100	▲ 33,400	▲ 4,000
当座預金残高	4,836,900	4,803,500	4,799,500
準備預金残高	4,252,200		
積み終了先	4,252,200		
超過準備	4,252,200		
非準備預金先	584,700		
積み期間(11/16~12/15)の所要準備額			3,451,500
準備預金進捗率	実績	0.00%	日数
		0.00%	

## ●2020年11月13日の市場動向

### <インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、邦銀を中心に▲0.04~▲0.015%での調達で始まった。実質的な積み最終日の取引であることに加え、週末要因も重なったためレート水準が若干上昇した。一巡後は▲0.03%近辺の出合いが数件見られる程度で、今週の取引を終えた。ターム物に関しては目立った出合いは見られなかった。

### <レポ市場>

GC T/N(11/16-11/17)は、▲0.08~▲0.075%程度での出合い。SCはロールオーバーを中心に幅広い銘柄で取引が見られた。個別銘柄では2Y410~418、5Y136~145、10Y345~360、20Y171~174、30Y65~68、40Y10~13等にビッドの出入りがあった。

### <短国市場>

本日はTB3M物(951回)の入札が実施された。WI取引において▲0.093~▲0.090%での出合いが見られる中、平均落札利回▲0.938%、按分落札利回▲0.0912%と、順調な結果となった。結果発表後のセカンダリーマーケットでは、▲0.116~▲0.110%出合いと、強含みで推移した。この他に、6M物が▲0.118%で出合った。

### <CP市場>

CP発行市場は卸売業態で大型発行があり、償還総額は1,000億円程度に対し発行総額は900億円程度となった。

## ●短期金融市場関連指標

2020/11/13	無担(速報)			有担(速報)			短国 売買参考統計値	東京 レポレート 平均値	JGB新発10年債		日経平均株価		ドル/円	
	単位:%	最低	最高	平均	最低	最高			平均	直近値	前日比	15時時点	前日比	為替(9時)
O/N	▲ 0.070	0.001	▲ 0.030				-	▲ 0.088	0.020	▲ 0.005	25,385.87	▲ 135.01	105.09-11	105.06-08
T/N			▲ 0.001				-	▲ 0.081						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.025	▲ 0.020	▲ 0.021				-	▲ 0.088						
2W	▲ 0.035	▲ 0.012	▲ 0.020				-	▲ 0.090						
3W							-	▲ 0.095						
1M	▲ 0.020	▲ 0.005	▲ 0.012				-	▲ 0.100						
3M								▲ 0.115						
6M								▲ 0.118						
1Y								▲ 0.140						
									日付	11/6	11/9	11/10	11/11	11/12
									日銀当預残	4,859,600	4,842,200	4,829,100	4,821,900	4,859,000
									準備預金残	4,233,700	4,231,100	4,238,400	4,232,700	4,259,500
									マネタリーベース	6,048,500	6,030,400	6,016,800	6,008,700	6,046,100
									無担O/N加重平均	▲0.029%	▲0.030%	▲0.034%	▲0.034%	▲0.034%
									コール市場残高	154,269	142,114	136,511	130,486	127,437
									うち無担	134,214	121,665	116,380	110,073	107,220
									うちO/N	77,481	73,727	75,597	69,155	67,222
									うち有担	20,055	20,449	20,131	20,413	20,217

## ●入札結果

名称	回号	表面利率	発行予定額	発行日	償還日	応募額(億円)	募入額(億円)	募入最低額	募入最高利回・利回較差	案分率	募入平均価格	募入平均利回・利回較差	第1非価格競争入札(億円)
国庫短期証券	951	-	75,500	2020/11/16	2021/2/22	213,400.3	61,608.5	100.0245	▲0.0912%	80.2802%	100.0252	▲0.0938%	13,891.0
エネルギー対策	-	-	6,500	2020/11/20	2021/11/22	168,815.0	6,499.90		0.0000%	3.8504%		0.0000%	

## ●オペ結果

種類	オファー額(億円・百万ドル)	スタート日	エンド日	貸付利率	応札総額(億円・百万ドル)	落札総額(億円・百万ドル)	按分レート・利回較差・価格較差	全取レート・利回較差・価格較差	平均落札レート・利回較差・価格較差	按分比率
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2020/11/13	2020/11/16	▲0.350	273	273		▲0.350	▲0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2020/11/13	2020/11/16	▲0.350	0	0				

## ●2020年11月16日の予定

\*政井日銀審議委員、道東地域金融経済懇談会において講演  
\*7-9月期のGDP1次速報(市場予想:前期比年率+18.9%)  
\*9月の石油等消費動態統計

\*流動性供給入札(5,000億円、11/17発行)

◆本資料は信頼できると思われる各種データに基づいて作成されておりますが、当社はその正確性、完全性を保証するものではありません。

◆本資料は何かの取引を誘引することを目的としたものではありません。売買に関する最終判断はお客様ご自身でなされますようお願い申し上げます。

◆金融商品のお取引には価格変動等によるリスクがあります。金融商品のお取引には手数料等をご負担頂くものがあります。金融商品取引法に基づきお渡しする書面や目録見書をよくお読みください。

セントラル短資株式会社 登録金融機関関東財務局長(登金)第526号 日本証券業協会加入